

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 Nrn. 1 und 3 PfandBG

**Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte**

**3. Quartal 2021**

| Gesamtbetrag der<br>im Umlauf befindlichen  | Nominalwert |          | Barwert  |          | Risikobarwert* |         |         |
|---|-------------|----------|----------|----------|----------------|---------|---------|
|   | Q3 2021     | Q3 2020  | Q3 2021  | Q3 2020  | Q3 2021        | Q3 2020 |         |
| <b>Hypothekendarfandbriefe</b>  | (Mio. €)    | 8.340,7  | 12.142,1 | 8.492,7  | 12.396,5       | -       | -       |
| darunter Derivate   | (Mio. €)    | -        | -        | -        | -              | -       | -       |
| <b>Deckungsmasse</b>  | (Mio. €)    | 17.612,9 | 17.629,0 | 18.815,2 | 18.865,7       | -       | -       |
| darunter Derivate   | (Mio. €)    | -        | -        | -        | -              | -       | -       |
| <b>Überdeckung</b>  | (Mio. €)    | 9.272,2  | 5.486,9  | 10.322,5 | 6.469,2        | 9.735,1 | 5.603,8 |
| Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf  |             | 111,2    | 45,2     | 121,5    | 52,2           | -       | -       |
| Überdeckung unter<br>Berücksichtigung des vdp-<br>Bonitätsdifferenzierungsmodells | (Mio. €)    | 9.272,2  | 5.486,9  | 10.322,5 | 6.469,2        |         |         |
| Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf  |             | 111,2    | 45,2     | 121,5    | 52,2           |         |         |

\* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde ein eigenes Risikomodel gem. § 5 Abs. 2 PfandBarwertV verwendet.

| Gesamtbetrag der<br>im Umlauf befindlichen  | Nominalwert |          | Barwert  |          | Risikobarwert* |         |         |
|---|-------------|----------|----------|----------|----------------|---------|---------|
|   | Q3 2021     | Q3 2020  | Q3 2021  | Q3 2020  | Q3 2021        | Q3 2020 |         |
| <b>Öffentlichen Pfandbriefe</b>   | (Mio. €)    | 28.736,8 | 28.318,7 | 32.373,3 | 33.321,4       | -       | -       |
| darunter Derivate   | (Mio. €)    | -        | -        | -        | -              | -       | -       |
| <b>Deckungsmasse</b>  | (Mio. €)    | 32.542,6 | 32.993,8 | 38.051,5 | 40.203,2       | -       | -       |
| darunter Derivate   | (Mio. €)    | -        | -        | -        | -              | -       | -       |
| <b>Überdeckung</b>  | (Mio. €)    | 3.805,8  | 4.675,1  | 5.678,2  | 6.881,8        | 5.009,7 | 6.171,7 |
| Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf  |             | 13,2     | 16,5     | 17,5     | 20,7           | -       | -       |
| Überdeckung unter<br>Berücksichtigung des vdp-<br>Bonitätsdifferenzierungsmodells | (Mio. €)    | 3.805,8  | 4.675,1  | 5.678,2  | 6.881,8        |         |         |
| Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf  |             | 13,2     | 16,5     | 17,5     | 20,7           |         |         |

\* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde ein eigenes Risikomodel gem. § 5 Abs. 2 PfandBarwertV verwendet.

Hinweis: Die Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells ist optional.

**Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen**  
**3. Quartal 2021**

| <b>Hypothekendarlehen</b>  | <b>Q3 2021</b>                    |                                | <b>Q3 2020</b>                    |                                |
|----------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|
|                            | <b>Pfandbriefumlauf</b><br>Mio. € | <b>Deckungsmasse</b><br>Mio. € | <b>Pfandbriefumlauf</b><br>Mio. € | <b>Deckungsmasse</b><br>Mio. € |
| <b>Restlaufzeit:</b>       |                                   |                                |                                   |                                |
| <= 0,5 Jahre               | 2.142,1                           | 941,7                          | 2.125,3                           | 1.402,0                        |
| > 0,5 Jahre und <= 1 Jahr  | 380,0                             | 1.085,6                        | 937,4                             | 1.903,9                        |
| > 1 Jahr und <= 1,5 Jahre  | 1.568,6                           | 1.332,3                        | 2.139,2                           | 845,1                          |
| > 1,5 Jahre und <= 2 Jahre | 15,0                              | 1.252,3                        | 1.130,0                           | 1.136,8                        |
| > 2 Jahre und <= 3 Jahre   | 1.798,0                           | 2.913,1                        | 1.575,2                           | 2.433,2                        |
| > 3 Jahre und <= 4 Jahre   | 2.260,0                           | 2.746,2                        | 1.798,0                           | 2.869,0                        |
| > 4 Jahre und <= 5 Jahre   | 7,0                               | 2.003,8                        | 2.260,0                           | 2.041,9                        |
| > 5 Jahre und <= 10 Jahre  | 120,0                             | 4.996,4                        | 77,0                              | 4.820,4                        |
| > 10 Jahre                 | 50,0                              | 341,5                          | 100,0                             | 176,7                          |

| <b>Öffentliche Pfandbriefe</b> | <b>Q3 2021</b>                    |                                | <b>Q3 2020</b>                    |                                |
|--------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|
|                                | <b>Pfandbriefumlauf</b><br>Mio. € | <b>Deckungsmasse</b><br>Mio. € | <b>Pfandbriefumlauf</b><br>Mio. € | <b>Deckungsmasse</b><br>Mio. € |
| <b>Restlaufzeit:</b>           |                                   |                                |                                   |                                |
| <= 0,5 Jahre                   | 1.443,8                           | 1.147,8                        | 1.211,2                           | 2.056,6                        |
| > 0,5 Jahre und <= 1 Jahr      | 2.360,5                           | 1.353,5                        | 2.098,2                           | 1.320,4                        |
| > 1 Jahr und <= 1,5 Jahre      | 2.412,2                           | 2.053,8                        | 1.301,1                           | 1.184,7                        |
| > 1,5 Jahre und <= 2 Jahre     | 3.378,4                           | 1.980,2                        | 2.357,7                           | 1.233,7                        |
| > 2 Jahre und <= 3 Jahre       | 4.194,9                           | 2.654,1                        | 4.259,9                           | 3.741,0                        |
| > 3 Jahre und <= 4 Jahre       | 2.260,3                           | 2.100,5                        | 2.648,3                           | 2.374,7                        |
| > 4 Jahre und <= 5 Jahre       | 1.725,5                           | 2.775,9                        | 1.542,7                           | 1.732,1                        |
| > 5 Jahre und <= 10 Jahre      | 7.136,9                           | 9.453,3                        | 8.283,0                           | 9.929,9                        |
| > 10 Jahre                     | 3.824,3                           | 9.023,5                        | 4.616,6                           | 9.420,7                        |

**Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen  
3. Quartal 2021**

| Deckungswerte                                   | Q3 2021<br>Mio. € | Q3 2020<br>Mio. € |
|---|-------------------|-------------------|
| Bis einschließlich 300 Tsd. €                   | 792,8             | 608,9             |
| Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. € | 236,3             | 167,2             |
| Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €  | 877,4             | 953,3             |
| Mehr als 10 Mio. €                              | 14.208,3          | 14.298,8          |
| <b>Summe</b>                                    | <b>16.114,8</b>   | <b>16.028,2</b>   |

**Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen  
3. Quartal 2021**

| Deckungswerte                                    | Q3 2021<br>Mio. € | Q3 2020<br>Mio. € |
|--|-------------------|-------------------|
| Bis einschließlich 10 Mio. €                     | 3.747,6           | 3.781,8           |
| Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. € | 8.131,2           | 8.585,2           |
| Mehr als 100 Mio. €                              | 20.634,8          | 20.489,3          |
| <b>Summe</b>                                     | <b>32.513,6</b>   | <b>32.856,3</b>   |

**Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen**

**als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.**

**3. Quartal 2021**

| Deckungswerte                     |            |                    |                         |                                       |                         |  |           |           |             |                     |                       |   |  |           |        |   | Gesamt-<br>betrag der<br>mindestens<br>90 Tage<br>rückstän-<br>digen<br>Leistungen | Gesamtbetrag dieser<br>Forderungen, soweit<br>der jeweilige Rückstand<br>mindestens 5 % der<br>Forderung beträgt |
|-----------------------------------|------------|--------------------|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--|-----------|-----------|-------------|---------------------|-----------------------|---|--|-----------|--------|---|--|--|
| Staat                             | 3. Quartal | Insgesamt          |                         |                                       |                         |  |           |           |             |                     |                       |   |  |           |        |   |  |  |
|                                   |            | Wohnwirtschaftlich |                         |                                       |                         |  |           |           | Gewerblich  |                     |                       |   |  |           |        |   |  |  |
|                                   |            | Insgesamt          | Eigentums-<br>wohnungen | Ein- und Zwei-<br>familien-<br>häuser | Mehrfamilien-<br>häuser | Unfertige und<br>noch nicht<br>ertragfähige<br>Neubauten | Bauplätze | Insgesamt | Bürogebäude | Handels-<br>gebäude | Industrie-<br>gebäude | Sonstige<br>gewerblich<br>genutzte<br>Gebäude | Unfertige und<br>noch nicht<br>ertragfähige<br>Neubauten | Bauplätze |        |   |  |  |
| Mio. €                            | Mio. €     | Mio. €             | Mio. €                  | Mio. €                                | Mio. €                  | Mio. €   | Mio. €    | Mio. €    | Mio. €      | Mio. €              | Mio. €                | Mio. €  | Mio. €   | Mio. €    | Mio. € |   |  |  |
| <b>Gesamtsumme - alle Staaten</b> | Jahr 2021  | 16.114,8           | 4.432,9                 | 209,9                                 | 603,2                   | 3.619,2  | 0,5       | 0,1       | 11.681,9    | 7.169,8             | 4.050,1               | 147,7   | 187,0  | 56,0      | 71,3   | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 16.028,2           | 4.139,3                 | 161,8                                 | 437,6                   | 3.539,3  | 0,5       | 0,1       | 11.888,9    | 7.160,1             | 4.225,0               | 199,8   | 239,2  | 62,7      | 2,1    | - | -  |  |
| <b>Deutschland</b>                | Jahr 2021  | 8.245,5            | 2.867,7                 | 209,9                                 | 603,2                   | 2.054,0  | 0,5       | 0,1       | 5.377,8     | 2.669,1             | 2.336,7               | 147,7   | 172,4  | 49,8      | 2,1    | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 8.374,8            | 2.791,7                 | 161,8                                 | 437,6                   | 2.191,7  | 0,5       | 0,1       | 5.583,1     | 2.667,2             | 2.434,1               | 199,8   | 223,8  | 56,1      | 2,1    | - | -  |  |
| <b>Belgien</b>                    | Jahr 2021  | 139,1              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 139,1       | 139,1               | -                     | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 107,8              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 107,8       | 107,8               | -                     | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Finnland</b>                   | Jahr 2021  | 323,9              | 12,2                    | -                                     | -                       | 12,2   | -         | -         | 311,7       | 122,7               | 189,0                 | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 303,9              | 12,2                    | -                                     | -                       | 12,2   | -         | -         | 291,7       | 115,8               | 175,9                 | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Frankreich</b>                 | Jahr 2021  | 1.030,7            | 16,0                    | -                                     | -                       | 16,0   | -         | -         | 1.014,7     | 664,6               | 280,9                 | -   | -  | -         | 69,2   | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 761,2              | 16,0                    | -                                     | -                       | 16,0   | -         | -         | 745,2       | 585,3               | 159,9                 | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Großbritannien</b>             | Jahr 2021  | 466,5              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 466,5       | 432,3               | 34,2                  | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 1.032,4            | 11,3                    | -                                     | -                       | 11,3   | -         | -         | 1.021,1     | 715,5               | 304,8                 | -   | 0,8  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Luxemburg</b>                  | Jahr 2021  | 175,8              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 175,8       | 175,8               | -                     | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 192,1              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 192,1       | 192,1               | -                     | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Niederlande</b>                | Jahr 2021  | 612,7              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 612,7       | 312,2               | 279,7                 | -   | 14,6   | 6,2       | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 504,3              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 504,3       | 289,9               | 193,2                 | -   | 14,6   | 6,6       | -      | - | -  |  |
| <b>Österreich</b>                 | Jahr 2021  | 120,4              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 120,4       | 85,5                | 34,9                  | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 120,4              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 120,4       | 85,5                | 34,9                  | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Polen</b>                      | Jahr 2021  | 1.102,2            | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 1.102,2     | 522,8               | 579,4                 | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 1.114,3            | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 1.114,3     | 479,4               | 634,9                 | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Schweden</b>                   | Jahr 2021  | 268,1              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 268,1       | 89,2                | 178,9                 | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 226,1              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 226,1       | 112,8               | 113,3                 | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Tschechien</b>                 | Jahr 2021  | 239,9              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 239,9       | 187,6               | 52,3                  | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 122,3              | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 122,3       | 70,0                | 52,3                  | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>Norwegen</b>                   | Jahr 2021  | 63,1               | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 63,1        | 63,1                | -                     | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 57,8               | -                       | -                                     | -                       | -  | -         | -         | 57,8        | 57,8                | -                     | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
| <b>USA</b>                        | Jahr 2021  | 3.326,9            | 1.537,0                 | -                                     | -                       | 1.537,0  | -         | -         | 1.789,9     | 1.705,8             | 84,1                  | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |
|                                   | Jahr 2020  | 3.110,8            | 1.308,1                 | -                                     | -                       | 1.308,1  | -         | -         | 1.802,7     | 1.681,0             | 121,7                 | -   | -  | -         | -      | - | -  |  |

**Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen**

**3. Quartal 2021**

| <b>Deckungswerte</b>              |                   |   |               |                             |  |                                       |                 |                                |  |                                       |                 |
|-----------------------------------|-------------------|---|---------------|-----------------------------|--|---------------------------------------|-----------------|--------------------------------|--|---------------------------------------|-----------------|
|                                   |                   | <b>Summe</b>  |               | <b>davon geschuldet von</b> |  |                                       |                 | <b>davon gewährleistet von</b> |  |                                       |                 |
|                                   |                   | <b>in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung</b> |               | <b>Zentralstaat</b>         | <b>Regionale Gebietskörperschaften</b> | <b>Örtliche Gebietskörperschaften</b> | <b>Sonstige</b> | <b>Zentralstaat</b>            | <b>Regionale Gebietskörperschaften</b> | <b>Örtliche Gebietskörperschaften</b> | <b>Sonstige</b> |
| <b>Staat</b>                      | <b>3. Quartal</b> | <b>Mio. €</b>   | <b>Mio. €</b> | <b>Mio. €</b>               | <b>Mio. €</b>                          | <b>Mio. €</b>                         | <b>Mio. €</b>   | <b>Mio. €</b>                  | <b>Mio. €</b>                          | <b>Mio. €</b>                         | <b>Mio. €</b>   |
| <b>Gesamtsumme - alle Staaten</b> | Jahr 2021         | 32.513,6  | 888,3         | 109,9                       | 10.176,7                               | 12.880,5                              | 4.487,9         | 909,0                          | 2.142,3                                | 1.705,5                               | 101,8           |
|                                   | Jahr 2020         | 32.856,3  | 933,3         | 109,9                       | 10.786,7                               | 12.976,0                              | 4.505,7         | 934,4                          | 1.569,4                                | 1.858,1                               | 116,1           |
| <b>Deutschland</b>                | Jahr 2021         | 30.236,3  | 752,5         | 51,1                        | 9.952,9                                | 12.682,3                              | 4.459,0         | 773,2                          | 1.364,6                                | 851,4                                 | 101,8           |
|                                   | Jahr 2020         | 30.384,7  | 771,9         | 51,1                        | 10.532,6                               | 12.751,4                              | 4.475,9         | 773,0                          | 754,4                                  | 930,2                                 | 116,1           |
| <b>Belgien</b>                    | Jahr 2021         | 817,2   | -             | -                           | -                                      | -                                     | 0,9             | -                              | 12,2                                   | 804,1                                 | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 877,9   | -             | -                           | -                                      | -                                     | -               | -                              | -                                      | 877,9                                 | -               |
| <b>Dänemark</b>                   | Jahr 2021         | 33,1  | 33,1          | -                           | -                                      | -                                     | -               | 33,1                           | -                                      | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 8,9   | 8,9           | -                           | -                                      | -                                     | -               | 8,9                            | -                                      | -                                     | -               |
| <b>Finnland</b>                   | Jahr 2021         | 20,0  | -             | -                           | -                                      | 20,0                                  | -               | -                              | -                                      | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 20,5  | -             | -                           | -                                      | 20,5                                  | -               | -                              | -                                      | -                                     | -               |
| <b>Frankreich</b>                 | Jahr 2021         | 358,0   | 19,0          | -                           | 164,8                                  | 146,2                                 | 28,0            | 19,0                           | -                                      | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 405,6   | 17,0          | -                           | 187,8                                  | 171,0                                 | 29,8            | 17,0                           | -                                      | -                                     | -               |
| <b>Großbritannien</b>             | Jahr 2021         | -   | -             | -                           | -                                      | -                                     | -               | -                              | -                                      | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 130,6   | 130,6         | -                           | -                                      | -                                     | -               | 130,6                          | -                                      | -                                     | -               |
| <b>Luxemburg</b>                  | Jahr 2021         | 1,1   | 1,1           | -                           | -                                      | -                                     | -               | 1,1                            | -                                      | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 2,1   | 2,1           | -                           | -                                      | -                                     | -               | 2,1                            | -                                      | -                                     | -               |
| <b>Österreich</b>                 | Jahr 2021         | 806,4   | 2,4           | 58,8                        | -                                      | -                                     | -               | 2,4                            | 745,2                                  | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 852,3   | 2,8           | 58,8                        | -                                      | -                                     | -               | 2,8                            | 790,7                                  | -                                     | -               |
| <b>Portugal</b>                   | Jahr 2021         | 50,0  | -             | -                           | -                                      | -                                     | -               | -                              | -                                      | 50,0                                  | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 50,0  | -             | -                           | -                                      | -                                     | -               | -                              | -                                      | 50,0                                  | -               |
| <b>Schweden</b>                   | Jahr 2021         | 27,7  | 27,7          | -                           | -                                      | -                                     | -               | 27,7                           | -                                      | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | -   | -             | -                           | -                                      | -                                     | -               | -                              | -                                      | -                                     | -               |
| <b>Spanien</b>                    | Jahr 2021         | 65,1  | -             | -                           | 12,8                                   | 32,0                                  | -               | -                              | 20,3                                   | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 77,4  | -             | -                           | 20,0                                   | 33,1                                  | -               | -                              | 24,3                                   | -                                     | -               |
| <b>Schweiz</b>                    | Jahr 2021         | 98,7  | 52,5          | -                           | 46,2                                   | -                                     | -               | 52,5                           | -                                      | -                                     | -               |
|                                   | Jahr 2020         | 46,3  | -             | -                           | 46,3                                   | -                                     | -               | -                              | -                                      | -                                     | -               |

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen  
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt  
3. Quartal 2021**

|                                   |            | Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen |              |   |  |          | Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt |              |   |  |          |
|-----------------------------------|------------|--|--------------|---|--|----------|--|--------------|---|--|----------|
|                                   |            | Summe  | davon        |   |  |          | Summe  | davon        |   |  |          |
|                                   |            |  | Zentralstaat | Regionale<br>Gebietskörper-<br>schaften | Örtliche<br>Gebietskörper-<br>schaften | Sonstige |  | Zentralstaat | Regionale<br>Gebietskörper-<br>schaften | Örtliche<br>Gebietskörper-<br>schaften | Sonstige |
| Staat                             | 3. Quartal | Mio. €   | Mio. €       | Mio. €                                  | Mio. €                                 | Mio. €   | Mio. €   | Mio. €       | Mio. €                                  | Mio. €                                 | Mio. €   |
| <b>Gesamtsumme - alle Staaten</b> | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Deutschland</b>                | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Belgien</b>                    | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Dänemark</b>                   | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Finnland</b>                   | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Frankreich</b>                 | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Großbritannien</b>             | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Luxemburg</b>                  | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Österreich</b>                 | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Portugal</b>                   | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Schweden</b>                   | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Spanien</b>                    | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
| <b>Schweiz</b>                    | Jahr 2021  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |
|                                   | Jahr 2020  | -  | -            | -                                       | -                                      | -        | -  | -            | -                                       | -                                      | -        |

**Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen**

**3. Quartal 2021**

| Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen nach § 19 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 2 und 3 PfandBG |            |                 |   |   |   |   |
|--|------------|-----------------|---|---|---|---|
| Staat  | 3. Quartal | Summe<br>Mio. € | davon   |   |   | Forderungen<br>i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 3<br>Mio. € |
|  |            |                 | Ausgleichsforderungen<br>i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 1<br>Mio. € | Forderungen i.S.d. § 19 Abs. 1 Nr. 2<br>Insgesamt<br>Mio. € | davon<br>gedeckte Schuld-<br>verschreibungen<br>i.S.d. Art. 129 Verordnung<br>(EU) Nr. 575/2013<br>Mio. € |   |
| <b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>  | Jahr 2021  | 1.498,1         | -   | 90,0  | -   | 1.408,1   |
|  | Jahr 2020  | 1.600,8         | -   | -   | -   | 1.600,8   |
| <b>Deutschland</b>   | Jahr 2021  | 1.233,1         | -   | -   | -   | 1.233,1   |
|  | Jahr 2020  | 1.500,8         | -   | -   | -   | 1.500,8   |
| <b>Frankreich</b>  | Jahr 2021  | 100,0           | -   | -   | -   | 100,0   |
|  | Jahr 2020  | 100,0           | -   | -   | -   | 100,0   |
| <b>Luxemburg</b>   | Jahr 2021  | 75,0            | -   | -   | -   | 75,0  |
|  | Jahr 2020  | -               | -   | -   | -   | -   |
| <b>Österreich</b>  | Jahr 2021  | 90,0            | -   | 90,0  | -   | -   |
|  | Jahr 2020  | -               | -   | -   | -   | -   |

**Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe**

**3. Quartal 2021**

| Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 Nr.1 und Nr. 2 PfandBG |            |        |   |   |   |
|---|------------|--------|---|---|---|
|   |            | Summe  | davon   |   |   |
|   |            |        | Ausgleichsforderungen<br>i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 1 | Forderungen i.S.d. § 20 Abs. 2 Nr. 2<br>Insgesamt | davon<br>gedeckte Schuld-<br>verschreibungen<br>i.S.d. Art. 129 Verordnung<br>(EU) Nr. 575/2013 |
| Staat   | 3. Quartal | Mio. € | Mio. €  | Mio. €  | Mio. €  |
| <b>Gesamtsumme - alle Staaten</b>   |            |        |   |   |   |
|   | Jahr 2021  | 29,0   | -   | -   | -   |
|   | Jahr 2020  | 137,5  | -   | 137,5   | -   |
| <b>Deutschland</b>  |            |        |   |   |   |
|   | Jahr 2021  | 29,0   | -   | -   | -   |
|   | Jahr 2020  | 137,5  | -   | 137,5   | -   |



**Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten**

**3. Quartal 2021**

| Hypothekendarlehen   |          |          |          |
|--|----------|----------|----------|
|  |          |          |          |
|  |          | Q3 2021  | Q3 2020  |
| <b>Umlaufende Pfandbriefe</b>  | (Mio. €) | 8.340,7  | 12.142,1 |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 9  | %        | 90,9     | 82,3     |
|  |          |          |          |
| <b>Deckungsmasse</b>   | (Mio. €) | 17.612,9 | 17.629,0 |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen<br>nach § 13 Abs. 1 überschreiten<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 7                                 | (Mio. €) | -        | -        |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach<br>§ 19 Abs. 1 Nr. 2 liegen<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 8                         | (Mio. €) | -        | -        |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach<br>§ 19 Abs. 1 Nr. 3 liegen<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 8                         | (Mio. €) | -        | -        |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 9  | %        | 62,8     | 61,0     |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung<br>je Fremdwährung in Mio. Euro<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)    | CAD      | -        | -        |
|  | CHF      | 12,9     | 54,3     |
|  | CZK      | -        | -        |
|  | DKK      | -        | -        |
|  | GBP      | 470,0    | 1.078,8  |
|  | HKD      | -        | -        |
|  | JPY      | -        | -        |
|  | NOK      | 65,2     | 61,2     |
|  | SEK      | 271,6    | 228,0    |
|  | USD      | 3.105,0  | 2.249,3  |
| AUD  | -        | -        |          |
| volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen<br>(verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning)<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 11 | Jahre    | 4,3      | 4,2      |
| durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf<br>§ 28 Abs. 2 Nr. 3  | %        | 59,0     | 59,0     |
| durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis<br>- freiwillige Angabe -  | %        | -        | -        |

## Öffentliche Pfandbriefe

|   |          | Q3 2021  | Q3 2020  |
|---|----------|----------|----------|
| <b>Umlaufende Pfandbriefe</b>   | (Mio. €) | 28.736,8 | 28.318,7 |
| davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 9   | %        | 76,3     | 89,2     |
| <b>Deckungsmasse</b>  | (Mio. €) | 32.542,6 | 32.993,8 |
| davon Gesamtbetrag der Forderungen, die oberhalb der %-Werte nach<br>§ 20 Abs. 2 liegen<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 8                            | (Mio. €) | -        | -        |
| davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 9   | %        | 94,9     | 94,5     |
| Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung<br>je Fremdwährung in Mio. Euro<br>§ 28 Abs. 1 Nr. 10 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite) | CAD      | -        | -        |
|   | CHF      | 133,1    | 137,6    |
|   | CZK      | -        | -        |
|   | DKK      | -        | -        |
|   | GBP      | -        | -        |
|   | HKD      | -        | -        |
|   | JPY      | 696,9    | 2,1      |
|   | NOK      | -        | -        |
|   | SEK      | -        | -        |
|   | USD      | 155,8    | 21,4     |
|   | AUD      | -        | -        |